

2020/12/16

农产品套利跟踪



信达期货
CINDA FUTURES

联系人：张秀峰

投资咨询编号：Z0011152

电话：0571-28132638

策略类型		策略组合	2020/12/15	2020/12/16	正常区间
跨品种	豆油/豆粕	Y2101/M2101	2.61	2.62	[1.8, 2.7]
		Y2105/M2105	2.40	2.40	[1.8, 2.7]
		Y2009/M2009	2.24	2.26	[1.8, 2.6]
		Y现货/M现货	2.58	2.58	[1.6, 2.5]
	菜油/菜粕	OI2101/RM2101	3.89	3.86	[2.5, 3.5]
		OI2105/RM2105	3.66	3.62	[2.5, 3.2]
		OI2009/RM2009	3.47	3.45	[2.3, 3.2]
		OI现货/RM现货	4.19	4.14	[2.3, 4.3]
	菜油-豆油	OI2101-Y2101	1648	1597	[0, 1000]
		OI2105-Y2105	1787	1740	[0, 1200]
		OI2009-Y2009	1772	1724	[0, 1200]
		OI现货-Y现货	2201	2165	[0, 1500]
	豆油-棕榈油	Y2101-P2101	1054	1046	[500, 1500]
		Y2105-P2105	878	838	[500, 1500]
		Y2009-P2009	930	932	[500, 1500]
		Y现货-P现货	1050	1040	[200, 1500]
	菜油-棕榈油	OI2101-P2101	2702	2643	[800, 2000]
		OI2105-P2105	2665	2578	[700, 2000]
		OI2009-P2009	2702	2656	[700, 2000]
		OI现货-P现货	3251	3205	[500, 3000]
	豆粕-菜粕	M2101-RM2101	574	577	[500, 1000]
		M2105-RM005	583	572	[400, 1000]
		M2009-RM2009	604	600	[400, 1000]
		M现货-RM现货	640	634	[400, 1500]

策略类型		策略组合	2020/12/15	2020/12/16	正常区间
跨期	豆粕	M2101-M2105	-62	-59	[0, 400]
		M2105-M2009	-48	-44	[-100, 200]
		M2009-M2101	110	103	[-100, 300]
		主力合约基差	-91	-82	[-200, 600]
	菜粕	RM2101-RM2105	-53	-64	[-100, 100]
		RM2105-RM2009	-27	-16	[-50, 150]
		RM2009-RM2101	80	80	[0, 350]
		主力合约基差	-27	-16	[0, 600]
	豆油	Y2101-Y2105	506	518	[-150, 150]
		Y2105-Y2009	378	366	[-250, 50]
		Y2009-Y2101	-884	-884	[-200, 0]
		主力合约基差	1020	1028	[-400, 150]
	棕榈油	P2101-P2105	330	310	[-300, 100]
		P2105-P2009	430	460	[-300, 200]
		P2009-P2101	-760	-770	[-200, 200]
		主力合约基差	750	770	[-500, 500]
	菜油	OI2101-OI2105	367	375	[-200, 100]
		O2105-OI2009	393	382	[-300, 200]
		OI2009-OI2101	-760	-757	[-200, 500]
		主力合约基差	1299	1319	[-100, 1000]
	玉米	C2101-C2105	-58	-66	[-100, 100]
		C2105-C2009	-22	-13	[-100, 150]
		C2009-C2101	80	79	[-100, 250]
		主力合约基差	19	-18	[-100, 400]
	白糖	SR2101-SR2105	21	2	[-150, 200]
		SR2105-SR2009	-41	-38	[-150, 200]
		SR2009-SR2101	20	36	[-300, 250]
		主力合约基差	22	8	[-300, 500]
	棉花	CF2101-CF2105	-150	-120	[-1000, 1000]
		CF2105-CF2009	-195	-180	[1000, 2000]
		CF2009-CF2101	345	300	[-1000, 1000]
		主力合约基差	-173	-152	[0, 2000]

--

操作建议
观望
观望
观望
-
观望
观望
观望
-
观望
-
观望
-
观望
观望
观望
-
观望
观望
观望
-
观望
观望
观望
-

